华富中证100指数证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2019年1月1日至2019年3月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中证100指数
交易代码	410008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月30日
报告期末基金份额总额	77,793,374.44份
投资目标	本基金采行被动式指数化投资,通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%和年跟踪误差不超过4%,以实现对中证100指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,本基金的标的指数为中证100指数,本基金原则上采用完全复制指数的投资策略,即按照标的指数成分股及其权重构建股票组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整,力争净值增长率与业绩比较基准之间的跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	754,287.09
2.本期利润	22,230,538.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.2820
4.期末基金资产净值	108,556,690.36
5.期末基金份额净值	1.3954

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

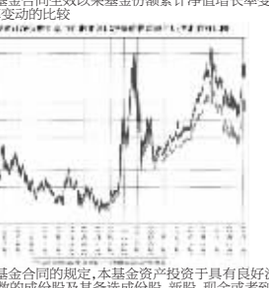
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	25.28%	1.47%	25.03%	1.50%	0.25%	-0.03%

注:业绩比较基准收益率=中证100指数收益率×95%+一年期银行定期存款收益率(税后)×5%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:根据基金合同的规定,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证100指数的成份股及其备选成份股、新股、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例为基金资产的90%~95%,基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为2009年12月30日至2010年6月30日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富中证100指数证券投资基金基金合同》的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高靖瑜	华富中证100指数基金基金经理、华富智慧城市灵活配置混合型基金基金经理、华富健康文化灵活配置混合型基金基金经理、华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理	2017年9月12日	-	十九年	复旦大学金融学硕士,本科学历。历任金鼎综合证券(集团)股份有限公司上海代表处研究员、上海天相投资咨询有限公司研究员、2007年7月加入华富基金管理有限公司,任行业研究员;2013年3月1日至2014年12月14日任华富价值增长混合型基金基金经理助理;2014年12月15日至2016年12月12日任华富策略精选灵活配置混合型基金基金经理。
郁哲	华富中证100指数基金基金经理、华富中小板指数增强型基金基金经理、华富水鑫灵活配置混合型基金基金经理、华富中证5年恒定久期国开债指数型基金基金经理助理	2018年2月23日	-	五年	北京大学理学博士,研究生学历,先后担任方正证券股份有限公司博士后研究员、上海国投资管理有限公司高级研究员,2017年4月加入华富基金管理有限公司。

注:这里的任职指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2019年一季度,风险偏好和经济数据均企稳,年初随着外资的流入风险偏好逐渐修复,快速上涨使得市场赚钱效应越来越强,进一步推高了涨幅,随着1月天量信贷的投放,部分资金在需求端尚未企稳恢复时进入市场。种种因素形成了1季度前两个月的快速上涨行情。

3月PMI显示了一定的量价齐升的态势,虽有季节性效应,但剔除后,仍显示出了一定的企稳迹象,只是持续性还有待进一步的验证。

2月的社融来看,虽然较一月明显下降,但1-2月合起来看,总量还是显出了一定的企稳迹象,但结构未能持续改善。

宏观配置模型显示依然处于收缩期,但资金驱动牛市比较明显,且未来有转为周期牛是的可能,因此可提前布局,提高仓位。

政策方面,政府大力推动金融供改,意在维持对科创行业的支持,比较强调直接融资的功能,因此市场整体大概率走成慢牛趋势,金融板块和科创龙头板块相对比较收益。

择时系统方面,从19年初至今,沪深300和上证50走出周线向上的确认。预计仍将有1倍的延伸幅度。

创业板目前日线级别下跌走完了11浪结构,下跌结束概率95%。从中期来看,创业板自2015年6月以来的周线级别下跌无论从时间、幅度还是结构上均已充分,从未来1-2年的中期来看,目前的位置就是中期底部。创业板下周有望形成周线向上确认,中小板确认尚需时日。

华富中证100指数基金为完全复制的指数基金,在2019年一季度中,我们实现了对业绩基准的有效跟踪,并通过打新策略,优化了基金的成本收益。

在2019年二季度内中,我们将继续通过严格的投资约束和数量化风险控制,力争实现对业绩基准的有效跟踪。同时叠加打新策略,在严格控制基金跟踪误差的前提下,适当优化基金的成本收益。为投资者提供有效跟踪中证100指数的投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金于2009年12月30日正式成立。截至2019年3月31日,本基金份额净值为1.3954元,累计基金份额净值为1.3954元。本基金本报告期份额净值增长率为25.28%,同期业绩比较基准收益率为25.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,480,988.65	93.41
	其中:股票	102,480,988.65	93.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,904,819.93	6.29
8	其他资产	324,697.34	0.30
9	合计	109,710,505.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,542,778.90	3.26
C	制造业	34,080,135.93	31.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,438,412.23	2.25
E	建筑业	4,086,403.55	3.76
F	批发和零售业	1,003,122.85	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	2,815,727.58	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,800,187.49	1.66
J	金融业	45,330,008.87	41.76
K	房地产业	5,273,317.88	4.86
L	租赁和商务服务业	1,440,692.46	1.33
M	科学研究和技术服务业	121,966.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	101,934,753.74	93.90

注:本基金本报告期指数投资部分含拟于2019年4月1日调入中证100指数的备选成分股,具体情况请查阅中证指数有限公司相关公告。因成份股停牌、流动性不足或法律法规中的投资比例限制等因素使得本基金无法购买中证100指数某成份股或者无法按照中证100指数某成份股的权重购买足够数量的该成份股时,本基金可以根据市场情况,买入该成份股的替代股票,以维持该成份股在本基金股票资产中的配置比例。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	389,479.51	0.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,890.50	0.02
J	金融业	129,864.90	0.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	546,234.91	0.50

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	133,828	10,318,138.80	9.50
2	600519	贵州茅台	6,192	5,287,906.08	4.87
3	600036	招商银行	128,046	4,343,320.32	4.00
4	000651	格力电器	60,844	2,872,445.24	2.65
5	000333	美的集团	58,473	2,849,389.29	2.62
6	601166	兴业银行	154,011	2,798,379.87	2.58
7	600030	中信证券	99,121	2,456,218.38	2.26
8	000858	五粮液	24,410	2,318,950.00	2.14
9	600887	伊利股份	76,591	2,229,564.01	2.05
10	601288	农业银行	592,264	2,209,144.72	2.04

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600485	信威集团	9,203	134,271.77	0.12
2	002958	青农商行	17,110	129,864.90	0.12
3	300762	上海瀚讯	937	62,675.93	0.06
4	300765	新诺威	1,130	59,878.70	0.06
5	002951	金时科技	1,675	57,653.50	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,147.84
2	应收证券清算款	308,220.35
3	应收股利	-
4	应收利息	1,515.99
5	应收申购款	15,813.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	324,697.34

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	134,271.77	0.12	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	78,774,850.16
报告期期间基金总申购份额	2,815,923.06
减:报告期期间基金总赎回份额	3,797,398.78
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	77,793,374.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内本基金管理人没有申购、赎回或者买卖本基金份额的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	1.1-3.31	47,910,118.82	0.00	0.00	47,910,118.82	61.59%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、华富中证100指数证券投资基金基金合同

2、华富中证100指数证券投资基金托管协议

3、华富中证100指数证券投资基金招募说明书

4、报告期内华富中证100指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

嘉实策略增长混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实策略混合
基金主代码	070011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月12日
报告期末基金份额总额	3,183,049,958.66份
投资目标	通过有效的策略组合,为基金持有人创造较高的中长期资产增值
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面进行综合分析,在具备足够多周期收益率良好的资产、股票投资采用自上而下和自下而上相结合的方法,主策略为积极成长策略,辅之以趋价证券策略和周期反转策略等,债券投资采取"自上而下"策略,以久期管理策略为主,辅以收益率曲线策略等。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	较高风险,较高收益。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-69,543,540.41
2.本期利润	864,418,960.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.2701
4.期末基金资产净值	3,526,496,232.51
5.期末基金份额净值	1.108

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	32.22%	1.68%	21.32%	1.17%	10.90%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

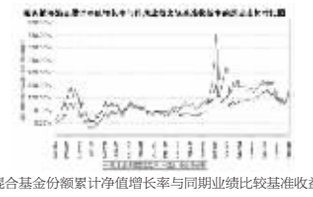


图:嘉实策略混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年12月12日至2019年3月31日)

注:按相关法规规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分(二、投资范围和六、(二)投资组合限制)的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢泽林	本基金、嘉实策略混合型基金、嘉实成长收益混合型基金基金经理	2016年9月30日	-	9年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部,曾任行业研究员一职,现任职于投资投资部,硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年1季度国内经济增速延续去年4季度的回落趋势,但货币流动性M1增速见底反转。政策层面在去年4季度发生重大转折,11月1日习近平主席出席民营企业家座谈会做重要讲话,12月21日中央经济工作会议定调宏观政策要强化逆周期调节,3月两会的政府工作报告继续释放政策利好,中美贸易摩擦也有积极进展。政府对经济托底,大幅提振了市场信心。A股在1季度迎来了久违的大幅上涨,沪深300指数上涨28.6%,中证500指数上涨33.1%,中证1000指数上涨33.4%。农业、计算机、非银、食品饮料等行业涨幅居前,银行、煤炭、公用事业等行业表现较差。行业的分化体现出市场风险偏好的变化。

报告期内本基金的配置重点继续聚焦在估值合理偏低的优质成长股,围绕科技和消费两大主线进行选股,主要包括网络安全、信息化、医疗健康、新零售、军工、房地产等领域的优质成长企业。组合净值1季度上涨32.2%,跑赢沪深300指数,但略跑输中证500、中证1000指数。业绩表现没有足够好,2季度和下半年仍需更加努力。中国经济中长期持续成长的韧性,使我们对未来经济保持乐观的心态,将积极从科技和消费两大主线,寻找景气和业绩有望超预期的细分领域和优质成长标的,努力在短期和中长期能给持有人带来良好投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.108元;本报告期基金份额净值增长率为32.22%,业绩比较基准收益率为21.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,303,670,394.62	93.39
	其中:股票	3,303,670,394.62	93.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	152,474,850.00	4.31
	其中:债券	152,474,850.00	4.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,856,551.95	2.14
8	其他资产	5,583,756.38	0.16
9	合计	3,537,585,552.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,820,514,212.35	51.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	126,945,624.09	3.60
F	批发和零售业	113,291,360.00	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	23,756,438.57	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	705,590,248.11	20.01
J	金融业	15,692,477.54	0.44
K	房地产业	400,639,415.89	11.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	86,844,815.27	2.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,415,802.80	0.30
S	综合	-	-
	合计	3,303,670,394.62	93.68

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002439	启明星辰	9,915,611	292,312,212.28	8.29
2	002614	奥佳华	13,272,991	278,863,540.91	7.91
3	600466	蓝光发展	19,723,315	145,558,064.70	4.13
4	002713	东易日盛	6,070,399	126,932,043.09	3.60
5	002368	太极股份	3,097,408	115,812,085.12	3.28
6	002024	苏宁易购	9,027,200	113,291,360.00	3.21
7	300232	洲明科技	7,526,326	107,475,935.28	3.05
8	000547	航天发展	9,610,467	105,234,613.65	2.98
9	300036	超图软件	5,914,710	104,572,072.80	2.97
10	002146	荣盛发展	8,994,403	101,187,033.75	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,351,000.00	3.70
	其中:政策性金融债	130,351,000.00	3.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	22,123,850.00	0.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	152,474,850.00	4.32

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180209	18国开09	1,300,000	130,351,000.00	3.70
2	128061	白明转债	115,834	11,583,400.00	0.33
3	128058	拓邦转债	98,248	9,824,800.00	0.28
4	123016	洲明转债	5,000	715,650.00	0.02

注:报告期末,本基金仅持有上述4支债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.11.2

本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	564,202.96
2	应收证券清算款	1,376,454.89
3	应收股利	-
4	应收利息	3,154,090.11
5	应收申购款	489,008.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,583,756.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,206,858,521.11
报告期期间基金总申购份额	56,677,544.21
减:报告期期间基金总赎回份额	80,486,106.66
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,183,049,958.66

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1) 中国证监会《关于同意嘉实策略增长混合型证券投资基金募集的批复》;

(2)《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实策略增长混合型证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实策略增长混合型证券投资基金基金托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6) 报告期内嘉实策略增长混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019年4月20日

嘉实成长收益证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本基金已根据香港《证券及期货条例》第104条在香港获得证券及期货事务监察委员会认可及可供在香港向公众销售。证券及期货事务监察委员会认可不代表对本基金的推荐或认许,亦不代表其对本基金的商业利弊或其表现作出保证。此并不意指本基金适合所有投资者,亦并非认许本基金适合任何特定投资者或投资者类别。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月5日
报告期末基金份额总额	3,382,397,537.11份
投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金,在获取稳定的现金收益的基础上,积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现"稳定收益"的目标;同时通过实施"行业优选、积极轮换"的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于中